**Raport 9/AS z badania rynku EURSEK**  TEWI 19.05.2013

1. **Wykonawca:**

Anton Smoliński

1. **Rynek:**

EURSEK próbkowany co 1h.

Dane z bossafx.pl. Ulokowane w m-pliku o nazwie EURSEK60.m zawierającym macierz o nazwie C o 2050 wierszach i 5 kolumnach: świeca OHLC i wolumen. Dane za okres – 7.01.2013 - 07.05.2013

1. **Wyniki testów**

Sprawdzono dla danych jak wyżej cztery skrypty S4a, S4b, S4c, S4d. Wszystkie cztery skrypty testowano dla tego przedziału czasowego rozpoczynając od świecy pocz=ma i kończąc na świecy kon=2050 (size(C)).

Każda zmienna zwrotu po jednej świecy miała inna nazwę nawiązująca do nazwy kwadrantu odpowiednio Ra, Rb, Rc, i Rd a krzywe zysku skumulowanego były oznaczone jako sumRa, sumRb, sumRc, sumRd.

Obliczano:

Zysk skumulowany na końcu szeregu czasowego sumR(kon);

Wskaźnik Calmara oznaczający stosunek powyższego zysku dla największego obsunięcia na krzywej zysku skumulowanego – Calmar; Dodatkowo policzono współczynnik SharpeRatio, którego zastosowanie pozwala określić stabilność zachowania strategii. Dla obydwu współczynników większa wartość oznacza lepszą strategię.

Liczbę otwieranych pozycji la, lb, … (procent spośród wszystkich testowanych świec)

Poszukiwano optymalnej wartości parametru m (liczby świec dla ustalenia średniej), dla której uzyskiwane były najlepsze wartości zysku. Parametry te odpowiednio oznaczono – ma, mb, …

Uzyskano nastepujące wyniki:

Dla S4a:

sumReturn = -0.08304

bestCalmar = 1.9261

la = 323

bestMa = 6

bestparamAVolLength = 5

bestparamADuration = 34

bestparamABuffer = -0.00576

bestparamAVolThreshold = -38

bestparamASL = 0.00192



Rys. 1. Krzywa zysku skumulowanego dla S4a

Dla S4b:

sumReturn = 2.3262

bestCalmar = 4.99

la = 459

bestMa = 14

bestparamBVolLength = 2

bestparamBDuration = 27

bestparamBBuffer = -0.00784

bestparamBVolThreshold = 30

bestparamBSL = 0.00896



Rys. 2. Krzywa zysku skumulowanego dla S4b

Dla S4c:

sumReturn = 0.10552

bestCalmar = 0.97093

la = 833

bestMa = 8

bestparamCVolLength = 4

bestparamCDuration = 4

bestparamCBuffer = 0.0056

bestparamCVolThreshold = 69

bestparamCSL = 0.00112



Rys. 3. Krzywa zysku skumulowanego dla S4c

Dla S4d:

sumReturn = 0.1008

bestCalmar = 0.79545

la = 790

bestMa = 31

bestparamDVolLength = 8

bestparamDDuration = 21

bestparamDBuffer = -0.00016

bestparamDVolThreshold = -18

bestparamDSL = 0.00096



Rys. 4. Krzywa zysku skumulowanego dla S4d